

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券	
信託期間	10年間（2012年9月28日～2022年9月27日）	
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。	
主要投資対象	為替ヘッジあり （毎月分配型）	イ、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミウム・トラストーダイワ／NB・ストラテジック・インカム・ファンド（円ヘッジクラス）」（以下「ストラテジック・インカム・ファンド（円ヘッジクラス）」といいます。）の受益証券（円建） ロ、ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券
	為替ヘッジなし （毎月分配型）	イ、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミウム・トラストーダイワ／NB・ストラテジック・インカム・ファンド（ノンヘッジクラス）」（以下「ストラテジック・インカム・ファンド（ノンヘッジクラス）」といいます。）の受益証券（円建） ロ、ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券
運用方法	為替ヘッジあり （毎月分配型）	①主として、ストラテジック・インカム・ファンド（円ヘッジクラス）の受益証券を通じて、米ドル建ての複数種別の債券等に分散投資を行なうとともに、機動的に配分比率を調整し、トータルリターンの最大化を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。 ②当ファンドは、ストラテジック・インカム・ファンド（円ヘッジクラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態で、ストラテジック・インカム・ファンド（円ヘッジクラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。 ③ストラテジック・インカム・ファンド（円ヘッジクラス）では、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。
	為替ヘッジなし （毎月分配型）	①主として、ストラテジック・インカム・ファンド（ノンヘッジクラス）の受益証券を通じて、米ドル建ての複数種別の債券等に分散投資を行なうとともに、機動的に配分比率を調整し、トータルリターンの最大化を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。 ②当ファンドは、ストラテジック・インカム・ファンド（ノンヘッジクラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態で、ストラテジック・インカム・ファンド（ノンヘッジクラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。 ③ストラテジック・インカム・ファンド（ノンヘッジクラス）では、為替変動リスクを低減するための為替ヘッジは原則として行ないません。
組入制限	投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、継続的な分配を行なうことを目標に分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。また、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。	

ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド
為替ヘッジあり（毎月分配型）
為替ヘッジなし（毎月分配型）

運用報告書（全体版）

第55期（決算日

2017年4月27日）

第56期（決算日

2017年5月29日）

第57期（決算日

2017年6月27日）

第58期（決算日

2017年7月27日）

第59期（決算日

2017年8月28日）

第60期（決算日

2017年9月27日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）／為替ヘッジなし（毎月分配型）」は、このたび、第60期の決算を行ないました。

ここに、第55期～第60期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託
Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先（コールセンター）
TEL 0120-106212
（営業日の9：00～17：00）
<http://www.daiwa-am.co.jp/> 〈5741〉
〈5742〉

為替ヘッジあり（毎月分配型）

最近30期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			ブルームバーグ・パークレイズ・ キャピタル米国債券総合 インデックス（米ドルベース）		公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純 資 産 総 額
	（分 配 落）	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率	（参考指数）	期 中 騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
31期末（2015年4月27日）	9,950	10	0.4	10,599	0.7	0.8	98.3	2,794
32期末（2015年5月27日）	9,861	10	△ 0.8	10,488	△ 1.0	0.7	98.4	2,709
33期末（2015年6月29日）	9,719	10	△ 1.3	10,331	△ 1.5	0.8	98.3	2,614
34期末（2015年7月27日）	9,671	10	△ 0.4	10,434	1.0	0.7	98.2	2,555
35期末（2015年8月27日）	9,504	10	△ 1.6	10,456	0.2	0.9	98.3	2,492
36期末（2015年9月28日）	9,471	10	△ 0.2	10,486	0.3	0.6	98.2	2,410
37期末（2015年10月27日）	9,537	10	0.8	10,575	0.8	0.9	98.0	2,331
38期末（2015年11月27日）	9,392	10	△ 1.4	10,488	△ 0.8	0.9	98.1	2,221
39期末（2015年12月28日）	9,235	10	△ 1.6	10,467	△ 0.2	0.7	98.1	2,162
40期末（2016年1月27日）	9,096	10	△ 1.4	10,573	1.0	0.8	98.1	2,105
41期末（2016年2月29日）	9,071	10	△ 0.2	10,668	0.9	0.7	98.0	2,029
42期末（2016年3月28日）	9,250	10	2.1	10,714	0.4	0.5	98.0	2,051
43期末（2016年4月27日）	9,374	10	1.4	10,762	0.5	0.4	98.0	2,029
44期末（2016年5月27日）	9,379	10	0.2	10,825	0.6	0.8	97.9	1,907
45期末（2016年6月27日）	9,386	10	0.2	10,959	1.2	0.2	97.8	1,849
46期末（2016年7月27日）	9,543	10	1.8	11,033	0.7	0.3	97.5	1,789
47期末（2016年8月29日）	9,593	10	0.6	11,041	0.1	0.8	97.9	1,749
48期末（2016年9月27日）	9,550	10	△ 0.3	11,075	0.3	—	97.6	1,666
49期末（2016年10月27日）	9,541	10	0.0	11,005	△ 0.6	0.3	97.6	1,594
50期末（2016年11月28日）	9,280	10	△ 2.6	10,708	△ 2.7	0.4	97.5	1,510
51期末（2016年12月27日）	9,264	10	△ 0.1	10,670	△ 0.4	—	97.4	1,477
52期末（2017年1月27日）	9,320	10	0.7	10,730	0.6	0.5	97.8	1,455
53期末（2017年2月27日）	9,425	10	1.2	10,855	1.2	0.4	97.9	1,442
54期末（2017年3月27日）	9,375	10	△ 0.4	10,821	△ 0.3	—	97.9	1,422
55期末（2017年4月27日）	9,392	10	0.3	10,891	0.6	0.6	97.9	1,346
56期末（2017年5月29日）	9,444	10	0.7	10,963	0.7	0.1	97.8	1,331
57期末（2017年6月27日）	9,468	10	0.4	11,057	0.9	0.0	97.7	1,238
58期末（2017年7月27日）	9,470	10	0.1	11,030	△ 0.2	0.0	99.2	1,228
59期末（2017年8月28日）	9,424	10	△ 0.4	11,103	0.7	—	99.1	1,196
60期末（2017年9月27日）	9,439	10	0.3	11,111	0.1	—	99.0	1,174

（注1）基準価額の騰落率は分配金込み。

（注2）ブルームバーグ・パークレイズ・キャピタル米国債券総合インデックス（米ドルベース）は、ブルームバーグ・パークレイズ・キャピタル米国債券総合インデックス（米ドルベース）の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。パークレイズは、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・バンク・ビーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグの採用ライセンスは、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

（注3）海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

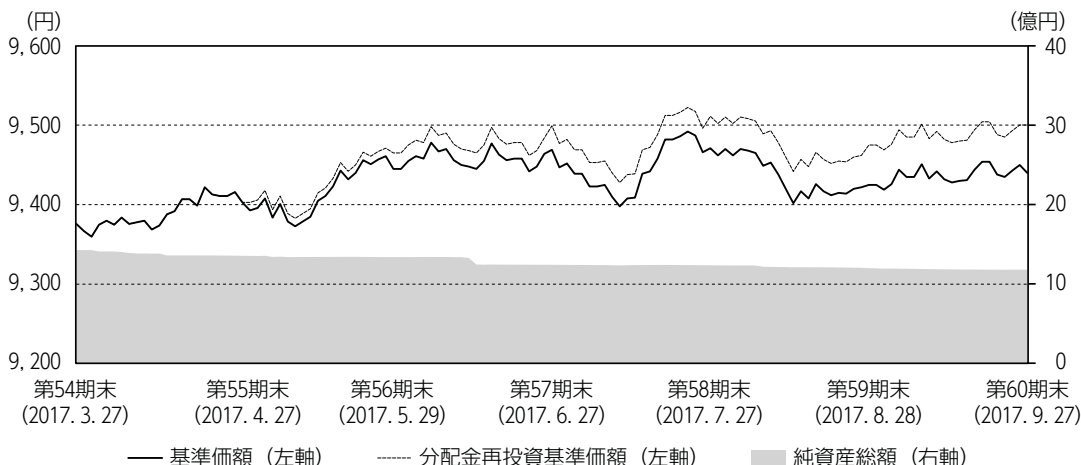
（注4）公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

（注5）公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。



運用経過

基準価額等の推移について



* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものであり、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまが利用するコースにより異なります。また、分配金の課税条件は、ファンドの購入価額により異なります。

基準価額・騰落率

第55期首：9,375円

第60期末：9,439円（既払分配金60円）

騰落率：1.3%（分配金再投資ベース）

基準価額の主な変動要因

「ダイワ・プレミアム・トラストーダイワ／NB・ストラテジック・インカム・ファンド（円ヘッジクラス）」（以下「ストラテジック・インカム・ファンド（円ヘッジクラス）」といいます。）の受益証券を通じて、米ドル建ての複数種別の債券等に分散投資し、為替ヘッジを行ない運用した結果、投資適格社債やハイ・イールド社債等が堅調に推移したことから基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）

	年 月 日	基 準 価 額		ブルームバーグ・パークレイズ・ キャピタル米国債券総合 インデックス（米ドルベース）		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
			騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
第55期	(期 首) 2017年 3 月27日	円 9,375	% —	10,821	% —	% —	% 97.9
	3 月末	9,379	0.0	10,815	△ 0.1	—	97.8
	(期 末) 2017年 4 月27日	9,402	0.3	10,891	0.6	0.6	97.9
第56期	(期 首) 2017年 4 月27日	9,392	—	10,891	—	0.6	97.9
	4 月末	9,395	0.0	10,902	0.1	0.6	97.9
	(期 末) 2017年 5 月29日	9,454	0.7	10,963	0.7	0.1	97.8
第57期	(期 首) 2017年 5 月29日	9,444	—	10,963	—	0.1	97.8
	5 月末	9,454	0.1	10,985	0.2	0.1	97.8
	(期 末) 2017年 6 月27日	9,478	0.4	11,057	0.9	0.0	97.7
第58期	(期 首) 2017年 6 月27日	9,468	—	11,057	—	0.0	97.7
	6 月末	9,438	△ 0.3	11,001	△ 0.5	0.0	97.7
	(期 末) 2017年 7 月27日	9,480	0.1	11,030	△ 0.2	0.0	99.2
第59期	(期 首) 2017年 7 月27日	9,470	—	11,030	—	0.0	99.2
	7 月末	9,469	△ 0.0	11,032	0.0	0.0	99.2
	(期 末) 2017年 8 月28日	9,434	△ 0.4	11,103	0.7	—	99.1
第60期	(期 首) 2017年 8 月28日	9,424	—	11,103	—	—	99.1
	8 月末	9,425	0.0	11,116	0.1	—	99.0
	(期 末) 2017年 9 月27日	9,449	0.3	11,111	0.1	—	99.0

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2017. 3. 28 ～ 2017. 9. 27）

■米国債券市況

米国債券市場では、金利はおおむね低下基調となりました。第55期首から2017年6月中旬にかけては、世界的な地政学リスクの高まりなどに振られながら金利は低下しました。6月下旬に入ると、米国で利上げが実施されたことや米国以外の先進各国でも金融政策の正常化が示唆されたことなどから金利が反発する局面も見られましたが、その後は9月上旬にかけて、トランプ政権の政策実行能力への懸念が高まったことや北朝鮮に関する地政学リスクが意識されたことなどから、金利低下圧力が継続しました。9月中旬以降は、FOMC（米国連邦公開市場委員会）で2017年内の利上げ見通しが据え置かれたほか、バランスシートの縮小開始が決定されたことなどから金利は上昇しました。

■短期金利市況

短期金利市況は、日本では日銀が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を維持し、短期金利は低位で推移しました。

一方、米国では、2017年6月に利上げを実施し、政策金利の誘導目標レンジを0.75～1.00%から1.00～1.25%に引き上げました。

前作成期間末における「今後の運用方針」

■当ファンド

ストラテジック・インカム・ファンド（円ヘッジクラス）への投資割合を高位に保つことによって、米ドル建ての複数種別の債券等に分散投資を行なうとともに、機動的に配分比率を調整し、トータルリターンの最大化を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

■ストラテジック・インカム・ファンド（円ヘッジクラス）

米ドル建ての複数種別の債券等に分散投資を行なうとともに、機動的に配分比率を調整し、トータルリターンの最大化を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。

■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行なう方針です。

ポートフォリオについて

（2017. 3. 28 ～ 2017. 9. 27）

■当ファンド

当ファンドは、ストラテジック・インカム・ファンド（円ヘッジクラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、当作成期間を通じてストラテジック・インカム・ファンド（円ヘッジクラス）への投資割合を高位に維持しました。

■ストラテジック・インカム・ファンド（円ヘッジクラス）

米ドル建ての複数種別の債券等（※）に分散投資を行なうとともに、機動的に配分比率を調整し、トータルリターンを最大化を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないました。債券種別では、政府系MBS（住宅ローン担保证券）や投資適格社債に対する組み入れを相対的に高い比率で維持しました。

また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないました。

※国債・政府機関債、投資適格社債、ハイ・イールド社債、資産担保证券、バンクローン等です。

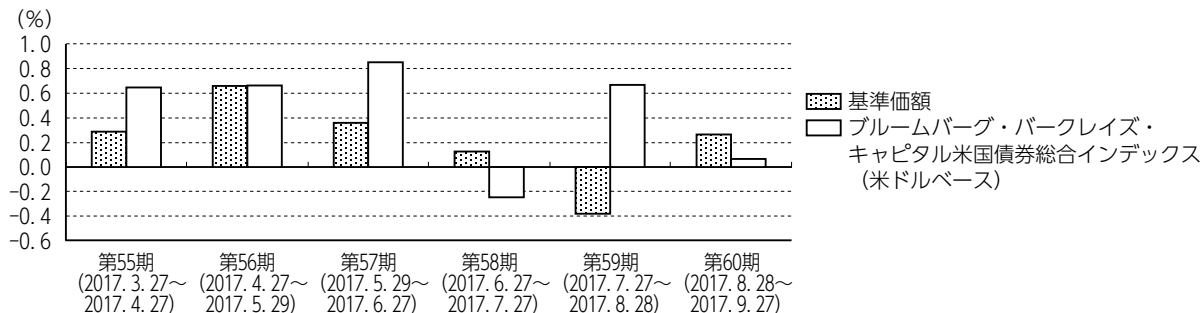
■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等による運用を行ないました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

第55期～第60期の1万口当り分配金（税込み）はそれぞれ10円といたしました。

収益分配金の決定根拠は下記の「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期
	2017年3月28日 ～2017年4月27日	2017年4月28日 ～2017年5月29日	2017年5月30日 ～2017年6月27日	2017年6月28日 ～2017年7月27日	2017年7月28日 ～2017年8月28日	2017年8月29日 ～2017年9月27日
当期分配金（税込み）（円）	10	10	10	10	10	10
対基準価額比率（％）	0.11	0.11	0.11	0.11	0.11	0.11
当期の収益（円）	10	10	10	10	9	10
当期の収益以外（円）	—	—	—	—	0	—
翌期繰越分配対象額（円）	907	916	922	923	922	926

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期
(a) 経費控除後の配当等収益	16.21円	18.11円	16.33円	11.56円	9.02円	13.92円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	33.26	33.59	33.91	34.20	34.49	34.78
(d) 分配準備積立金	868.44	874.33	882.12	888.16	889.45	888.18
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	917.92	926.03	932.37	933.94	932.97	936.89
(f) 分配金	10.00	10.00	10.00	10.00	10.00	10.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	907.92	916.03	922.37	923.94	922.97	926.89

(注) 下線を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

ストラテジック・インカム・ファンド（円ヘッジクラス）への投資割合を高位に保つことによって、米ドル建ての複数種別の債券等に分散投資を行なうとともに、機動的に配分比率を調整し、トータルリターンの最大化を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

■ストラテジック・インカム・ファンド（円ヘッジクラス）

米ドル建ての複数種別の債券等に分散投資を行なうとともに、機動的に配分比率を調整し、トータルリターンの最大化を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

また、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行ないます。

■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行なう方針です。

1 万口当りの費用の明細

項 目	第55期～第60期 (2017. 3. 28～2017. 9. 27)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	57円	0. 605%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は9, 430円です。
（投信会社）	(18)	(0. 187)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
（販売会社）	(38)	(0. 402)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託銀行）	(1)	(0. 016)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	0	0. 004	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0. 004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	57	0. 609	

- （注 1）期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。
- （注 2）各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1 万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。
- （注 3）金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。
- （注 4）比率欄は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2017年 3月28日から2017年 9月27日まで)

決 算 期	第 55 期 ～ 第 60 期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
外国（邦貨建）	443.78	38,835	3,166.01	277,000

(注 1) 買付は、外国投資信託から支払われた分配金による再投資分を含みます。
(注 2) 金額は受渡し代金。
(注 3) 金額の単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
投資信託受益証券

(2017年 3月28日から2017年 9月27日まで)

第 55 期 ～ 第 60 期							
買 付				売 付			
銘 柄	□ 数	金 額	平均単価	銘 柄	□ 数	金 額	平均単価
	千□	千円	円		千□	千円	円
NB STRATEGIC INCOME FUND JPY HEDGED CLASS（ケイマン諸島）	255.973	22,400	87	NB STRATEGIC INCOME FUND JPY HEDGED CLASS（ケイマン諸島）	3,166.01	277,000	87

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) 当ファンドにおける当作成期間中の利害関係人との取引状況

当作成期間（第55期～第60期）中における利害関係人との取引はありません。

(2) ダイワ・マネーアセット・マザーファンドにおける当作成期間中の利害関係人との取引状況

(2017年 3月28日から2017年 9月27日まで)

決 算 期	第 55 期 ～ 第 60 期					
	買付額等 A	うち 利 害 関係人との 取引状況 B		売付額等 C	うち 利 害 関係人との 取引状況 D	
		B/A			D/C	
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	15,770	3,110	19.7	—	—	—
コール・ローン	1,489,190	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合 0.1%
※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ペーパーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年 3月28日から2017年 9月27日まで)

決 算 期	第 55 期 ～ 第 60 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	—	—	22,498	22,525

(注) 単位未満は切捨て。

(3) 当作成期間中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当作成期間（第55期～第60期）中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第 1 項に規定される利害関係人であり、当作成期間における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	第 60 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) NB STRATEGIC INCOME FUND JPY HEDGED CLASS	13, 278. 894	1, 163, 549	99. 0

(注 1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注 2) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年 9月27日現在

項 目	第 60 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	1, 163, 549	98. 8
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	1	0. 0
コール・ローン等、その他	13, 893	1. 2
投資信託財産総額	1, 177, 444	100. 0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	第54期末	第 60 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	22, 499	1	1

(注) 単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2017年 4月27日)、(2017年 5月29日)、(2017年 6月27日)、(2017年 7月27日)、(2017年 8月28日)、(2017年 9月27日) 現在

項 目	第55期末	第56期末	第57期末	第58期末	第59期末	第60期末
(A) 資産	1, 350, 622, 601円	1, 338, 615, 225円	1, 242, 823, 812円	1, 238, 199, 979円	1, 213, 536, 066円	1, 182, 444, 986円
コール・ローン等	9, 716, 006	9, 451, 523	9, 009, 275	8, 635, 393	8, 317, 906	8, 893, 923
投資信託受益証券（評価額）	1, 318, 378, 108	1, 302, 637, 466	1, 209, 288, 300	1, 219, 563, 351	1, 185, 216, 925	1, 163, 549, 827
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド（評価額）	22, 528, 487	22, 526, 237	22, 526, 237	1, 236	1, 236	1, 236
未収入金	—	3, 999, 999	2, 000, 000	9, 999, 999	19, 999, 999	10, 000, 000
(B) 負債	3, 780, 967	6, 991, 117	4, 718, 243	9, 405, 673	17, 451, 961	7, 481, 741
未払金	—	2, 000, 000	1, 000, 000	5, 000, 000	10, 000, 000	5, 000, 000
未払収益分配金	1, 433, 990	1, 409, 965	1, 307, 709	1, 297, 518	1, 269, 143	1, 244, 737
未払解約金	911, 489	2, 131, 565	1, 135, 240	1, 835, 192	4, 840, 650	—
未払信託報酬	1, 425, 824	1, 430, 662	1, 248, 098	1, 237, 566	1, 298, 169	1, 185, 153
その他未払費用	9, 664	18, 925	27, 196	35, 397	43, 999	51, 851
(C) 純資産総額（A－B）	1, 346, 841, 634	1, 331, 624, 108	1, 238, 105, 569	1, 228, 794, 306	1, 196, 084, 105	1, 174, 963, 245
元本	1, 433, 990, 038	1, 409, 965, 387	1, 307, 709, 731	1, 297, 518, 910	1, 269, 143, 473	1, 244, 737, 151
次期繰越損益金	△ 87, 148, 404	△ 78, 341, 279	△ 69, 604, 162	△ 68, 724, 604	△ 73, 059, 368	△ 69, 773, 906
(D) 受益権総口数	1, 433, 990, 038□	1, 409, 965, 387□	1, 307, 709, 731□	1, 297, 518, 910□	1, 269, 143, 473□	1, 244, 737, 151□
1万口当り基準価額（C／D）	9, 392円	9, 444円	9, 468円	9, 470円	9, 424円	9, 439円

* 第54期末における元本額は1, 517, 365, 485円、当作成期間（第55期～第60期）中における追加設定元本額は2, 909, 648円、同解約元本額は275, 537, 982円です。

* 第60期末の計算口数当りの純資産額は9, 439円です。

* 第60期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は69, 773, 906円です。

ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）

■損益の状況

第55期	自2017年 3月28日	至2017年 4月27日	第57期	自2017年 5月30日	至2017年 6月27日	第59期	自2017年 7月28日	至2017年 8月28日
第56期	自2017年 4月28日	至2017年 5月29日	第58期	自2017年 6月28日	至2017年 7月27日	第60期	自2017年 8月29日	至2017年 9月27日
項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期		
(A) 配当等収益	3, 178, 341円	2, 974, 700円	2, 752, 581円	2, 644, 994円	2, 452, 719円	2, 394, 764円		
受取配当金	3, 178, 792	2, 975, 152	2, 753, 125	2, 645, 428	2, 453, 253	2, 395, 266		
受取利息	6	1	13	1	3	1		
支払利息	△ 457	△ 453	△ 557	△ 435	△ 537	△ 503		
(B) 有価証券売買損益	2, 176, 869	7, 222, 537	2, 867, 333	235, 401	△ 5, 714, 474	1, 923, 499		
売買益	2, 229, 955	7, 283, 813	2, 899, 677	254, 900	90, 279	1, 937, 578		
売買損	△ 53, 086	△ 61, 276	△ 32, 344	△ 19, 499	△ 5, 804, 753	△ 14, 079		
(C) 信託報酬等	△ 1, 435, 569	△ 1, 440, 187	△ 1, 256, 369	△ 1, 245, 767	△ 1, 306, 771	△ 1, 193, 005		
(D) 当期損益金 (A + B + C)	3, 919, 641	8, 757, 050	4, 363, 545	1, 634, 628	△ 4, 568, 526	3, 125, 258		
(E) 前期繰越損益金	△ 86, 765, 123	△ 82, 836, 466	△ 69, 989, 255	△ 66, 390, 110	△ 64, 587, 568	△ 69, 047, 879		
(F) 追加信託差損益金	△ 2, 868, 932	△ 2, 851, 898	△ 2, 670, 743	△ 2, 671, 604	△ 2, 634, 131	△ 2, 606, 548		
(配当等相当額)	(4, 769, 829)	(4, 736, 083)	(4, 434, 894)	(4, 438, 010)	(4, 377, 528)	(4, 330, 275)		
(売買損益相当額)	(△ 7, 638, 761)	(△ 7, 587, 981)	(△ 7, 105, 637)	(△ 7, 109, 614)	(△ 7, 011, 659)	(△ 6, 936, 823)		
(G) 合計 (D + E + F)	85, 714, 414	76, 931, 314	68, 296, 453	67, 427, 086	71, 790, 225	68, 529, 169		
(H) 収益分配金	△ 1, 433, 990	△ 1, 409, 965	△ 1, 307, 709	△ 1, 297, 518	△ 1, 269, 143	△ 1, 244, 737		
次期繰越損益金 (G + H)	△ 87, 148, 404	△ 78, 341, 279	△ 69, 604, 162	△ 68, 724, 604	△ 73, 059, 368	△ 69, 773, 906		
追加信託差損益金	△ 2, 868, 932	△ 2, 851, 898	△ 2, 670, 743	△ 2, 671, 604	△ 2, 634, 131	△ 2, 606, 548		
(配当等相当額)	(4, 769, 829)	(4, 736, 083)	(4, 434, 894)	(4, 438, 010)	(4, 377, 528)	(4, 330, 275)		
(売買損益相当額)	(△ 7, 638, 761)	(△ 7, 587, 981)	(△ 7, 105, 637)	(△ 7, 109, 614)	(△ 7, 011, 659)	(△ 6, 936, 823)		
分配準備積立金	125, 425, 522	124, 421, 567	116, 184, 777	115, 445, 204	112, 760, 776	111, 043, 819		
繰越損益金	△ 209, 704, 994	△ 199, 910, 948	△ 183, 118, 196	△ 181, 498, 204	△ 183, 186, 013	△ 178, 211, 177		

(注 1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注 2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注 3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期
(a) 経費控除後の配当等収益	2, 325, 393円	2, 553, 504円	2, 136, 225円	1, 501, 029円	1, 145, 948円	1, 733, 123円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	4, 769, 829	4, 736, 083	4, 434, 894	4, 438, 010	4, 377, 528	4, 330, 275
(d) 分配準備積立金	124, 534, 119	123, 278, 028	115, 356, 261	115, 241, 693	112, 883, 971	110, 555, 433
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	131, 629, 341	130, 567, 615	121, 927, 380	121, 180, 732	118, 407, 447	116, 618, 831
(f) 分配金	1, 433, 990	1, 409, 965	1, 307, 709	1, 297, 518	1, 269, 143	1, 244, 737
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	130, 195, 351	129, 157, 650	120, 619, 671	119, 883, 214	117, 138, 304	115, 374, 094
(h) 受益権総口数	1, 433, 990, 038口	1, 409, 965, 387口	1, 307, 709, 731口	1, 297, 518, 910口	1, 269, 143, 473口	1, 244, 737, 151口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1 万 口 当 り 分 配 金	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期
	10円	10円	10円	10円	10円	10円
（単 価）	(9, 392円)	(9, 444円)	(9, 468円)	(9, 470円)	(9, 424円)	(9, 439円)

●＜分配金再投資コース＞をご利用の方の税引き分配金は、上記（ ）内の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については、20.315％（所得税15％、復興特別所得税0.315％および地方税5％）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合、税率が異なります。
- ・税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

為替ヘッジなし（毎月分配型）

最近30期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			ブルームバーグ・パークレイズ・ キャピタル米国債券総合 インデックス（円換算）		公 社 債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純 資 産 総 額
	（分 配 落）	税 込 分 配 金	期 騰 落 率	（参考指数）	期 騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
31期末（2015年4月27日）	14,576	70	0.4	16,243	0.5	0.2	98.9	622
32期末（2015年5月27日）	14,887	70	2.6	16,625	2.4	0.2	99.2	614
33期末（2015年6月29日）	14,734	70	△ 0.6	16,369	△ 1.5	0.2	99.1	585
34期末（2015年7月27日）	14,588	70	△ 0.5	16,630	1.6	0.2	99.2	580
35期末（2015年8月27日）	13,761	70	△ 5.2	16,177	△ 2.7	0.3	98.8	539
36期末（2015年9月28日）	13,855	70	1.2	16,270	0.6	0.2	99.1	526
37期末（2015年10月27日）	13,917	70	1.0	16,456	1.1	0.3	99.2	504
38期末（2015年11月27日）	13,878	70	0.2	16,589	0.8	0.3	99.1	508
39期末（2015年12月28日）	13,315	70	△ 3.6	16,256	△ 2.0	0.2	99.1	494
40期末（2016年1月27日）	12,862	70	△ 2.9	16,112	△ 0.9	0.2	98.4	472
41期末（2016年2月29日）	12,290	70	△ 3.9	15,620	△ 3.1	0.2	99.0	436
42期末（2016年3月28日）	12,357	70	1.1	15,662	0.3	0.1	99.0	434
43期末（2016年4月27日）	12,322	70	0.3	15,433	△ 1.5	0.1	99.0	431
44期末（2016年5月27日）	12,121	70	△ 1.1	15,315	△ 0.8	0.3	99.0	420
45期末（2016年6月27日）	11,250	70	△ 6.6	14,430	△ 5.8	0.0	99.0	425
46期末（2016年7月27日）	11,694	70	4.6	14,946	3.6	0.1	99.0	411
47期末（2016年8月29日）	11,252	70	△ 3.2	14,491	△ 3.0	0.2	99.0	388
48期末（2016年9月27日）	11,150	70	△ 0.3	14,318	△ 1.2	—	98.8	373
49期末（2016年10月27日）	11,541	70	4.1	14,824	3.5	0.1	99.0	384
50期末（2016年11月28日）	12,106	70	5.5	15,487	4.5	0.1	98.4	394
51期末（2016年12月27日）	12,525	70	4.0	16,149	4.3	—	98.9	404
52期末（2017年1月27日）	12,271	70	△ 1.5	15,847	△ 1.9	0.1	97.8	397
53期末（2017年2月27日）	12,108	70	△ 0.8	15,692	△ 1.0	0.1	99.0	388
54期末（2017年3月27日）	11,873	70	△ 1.4	15,400	△ 1.9	—	99.0	400
55期末（2017年4月27日）	11,915	70	0.9	15,628	1.5	0.2	98.9	403
56期末（2017年5月29日）	11,903	70	0.5	15,730	0.7	0.0	99.0	387
57期末（2017年6月27日）	11,911	70	0.7	15,951	1.4	0.0	98.9	370
58期末（2017年7月27日）	11,937	70	0.8	15,763	△ 1.2	0.0	99.3	367
59期末（2017年8月28日）	11,549	70	△ 2.7	15,612	△ 1.0	—	99.2	352
60期末（2017年9月27日）	11,842	70	3.1	16,092	3.1	—	99.4	354

（注1）基準価額の騰落率は分配金込み。

（注2）ブルームバーグ・パークレイズ・キャピタル米国債券総合インデックス（円換算）は、ブルームバーグ・パークレイズ・キャピタル米国債券総合インデックス（米ドルベース）をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。パークレイズは、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

（注3）海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

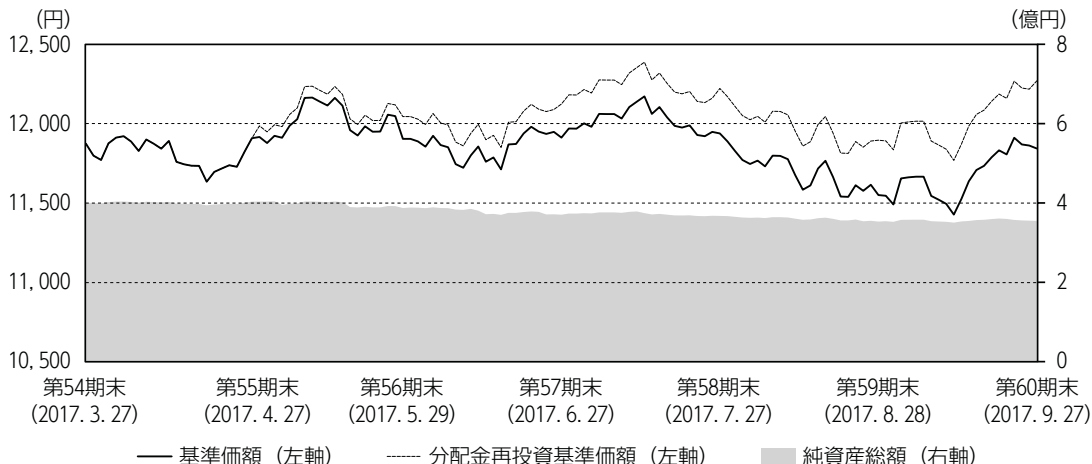
（注4）公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

（注5）公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。



運用経過

基準価額等の推移について



* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものであり、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまが利用するコースにより異なります。また、分配金の課税条件は、ファンドの購入価額により異なります。

基準価額・騰落率

第55期首：11,873円

第60期末：11,842円（既払分配金420円）

騰落率：3.3%（分配金再投資ベース）

基準価額の主な変動要因

「ダイワ・プレミアム・トラスト・ダイワ／NB・ストラテジック・インカム・ファンド（ノンヘッジクラス）」（以下「ストラテジック・インカム・ファンド（ノンヘッジクラス）」といいます。）の受益証券を通じて、米ドル建ての複数種別の債券等に分散投資し運用した結果、投資適格社債やハイ・イールド社債等が堅調に推移したことや、為替相場において米ドルが円に対して上昇したことなどから基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし（毎月分配型）

	年 月 日	基 準 価 額		ブルームバーグ・パークレイズ・ キャピタル米国債券総合 インデックス（円換算）		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
			騰 落 率	（参考指数）	騰 落 率		
第55期		円	%		%		%
	（期 首）2017年 3 月27日	11,873	—	15,400	—	—	99.0
	3 月末	11,911	0.3	15,635	1.5	—	99.0
第56期	（期 末）2017年 4 月27日	11,985	0.9	15,628	1.5	0.2	98.9
	（期 首）2017年 4 月27日	11,915	—	15,628	—	0.2	98.9
	4 月末	11,877	△ 0.3	15,635	0.0	0.2	98.6
第57期	（期 末）2017年 5 月29日	11,973	0.5	15,730	0.7	0.0	99.0
	（期 首）2017年 5 月29日	11,903	—	15,730	—	0.0	99.0
	5 月末	11,887	△ 0.1	15,707	△ 0.1	0.0	98.7
第58期	（期 末）2017年 6 月27日	11,981	0.7	15,951	1.4	0.0	98.9
	（期 首）2017年 6 月27日	11,911	—	15,951	—	0.0	98.9
	6 月末	12,001	0.8	15,877	△ 0.5	0.0	98.9
第59期	（期 末）2017年 7 月27日	12,007	0.8	15,763	△ 1.2	0.0	99.3
	（期 首）2017年 7 月27日	11,937	—	15,763	—	0.0	99.3
	7 月末	11,828	△ 0.9	15,688	△ 0.5	0.0	99.0
第60期	（期 末）2017年 8 月28日	11,619	△ 2.7	15,612	△ 1.0	—	99.2
	（期 首）2017年 8 月28日	11,549	—	15,612	—	—	99.2
	8 月末	11,654	0.9	15,817	1.3	—	98.9
	（期 末）2017年 9 月27日	11,912	3.1	16,092	3.1	—	99.4

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2017. 3. 28 ～ 2017. 9. 27）

■米国債券市況

米国債券市場では、金利はおおむね低下基調となりました。第55期首から2017年6月中旬にかけては、世界的な地政学リスクの高まりなどに振られながら金利は低下しました。6月下旬に入ると、米国で利上げが実施されたことや米国以外の先進各国でも金融政策の正常化が示唆されたことなどから金利が反発する局面も見られましたが、その後は9月上旬にかけて、トランプ政権の政策実行能力への懸念が高まったことや北朝鮮に関する地政学リスクが意識されたことなどから、金利低下圧力が継続しました。9月中旬以降は、FOMC（米国連邦公開市場委員会）で2017年内の利上げ見通しが据え置かれたほか、バランスシートの縮小開始が決定されたことなどから金利は上昇しました。

■為替相場

米ドルは対円でおおむねボックス圏で推移しました。米国の金融政策などを受けて米ドルが買われる局面も見られましたが、当作成期間を通じて、トランプ政権の政策実行能力への懸念や北朝鮮に関する地政学リスクの高まりなどを受け、投資家のリスク選好度の低下から円高米ドル安に振れやすい相場となりました。

前作成期間末における「今後の運用方針」

■当ファンド

ストラテジック・インカム・ファンド（ノンヘッジクラス）への投資割合を高位に保つことによって、米ドル建ての複数種別の債券等に分散投資を行なうとともに、機動的に配分比率を調整し、トータルリターンの最大化を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

■ストラテジック・インカム・ファンド（ノンヘッジクラス）

米ドル建ての複数種別の債券等に分散投資を行なうとともに、機動的に配分比率を調整し、トータルリターンの最大化を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行なう方針です。

ポートフォリオについて

（2017. 3. 28 ～ 2017. 9. 27）

■当ファンド

当ファンドは、ストラテジック・インカム・ファンド（ノンヘッジクラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズであり、当作成期間を通じてストラテジック・インカム・ファンド（ノンヘッジクラス）への投資割合を高位に維持しました。

■ストラテジック・インカム・ファンド（ノンヘッジクラス）

米ドル建ての複数種別の債券等（※）に分散投資を行なうとともに、機動的に配分比率を調整し、トータルリターンの最大化を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないました。債券種別では、政府系MBS（住宅ローン担保证券）や投資適格社債に対する組み入れを相対的に高い比率で維持しました。

※国債・政府機関債、投資適格社債、ハイ・イールド社債、資産担保证券、バンクローン等です。

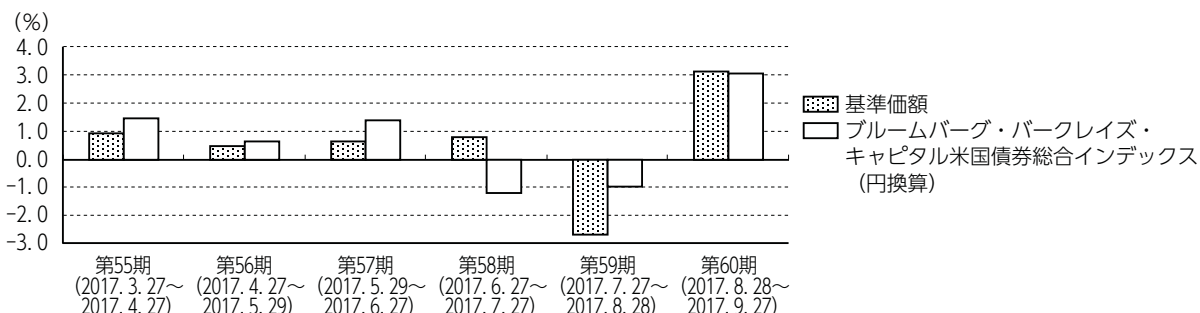
■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等による運用を行ないました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

第55期～第60期の1万口当り分配金（税込み）はそれぞれ70円といたしました。

収益分配金の決定根拠は下記の「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期
	2017年 3月28日 ～2017年 4月27日	2017年 4月28日 ～2017年 5月29日	2017年 5月30日 ～2017年 6月27日	2017年 6月28日 ～2017年 7月27日	2017年 7月28日 ～2017年 8月28日	2017年 8月29日 ～2017年 9月27日
当期分配金（税込み）（円）	70	70	70	70	70	70
対基準価額比率（％）	0.58	0.58	0.58	0.58	0.60	0.59
当期の収益（円）	33	28	30	32	22	34
当期の収益以外（円）	36	41	39	37	47	35
翌期繰越分配対象額（円）	3,752	3,710	3,671	3,634	3,586	3,551

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期
(a) 経費控除後の配当等収益	33.95円	28.36円	30.94円	32.37円	22.68円	34.05円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	2,533.92	2,537.64	2,541.19	2,544.57	2,547.97	2,551.51
(d) 分配準備積立金	1,254.72	1,214.97	1,169.77	1,127.34	1,086.32	1,035.47
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	3,822.61	3,780.97	3,741.92	3,704.30	3,656.98	3,621.04
(f) 分配金	70.00	70.00	70.00	70.00	70.00	70.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	3,752.61	3,710.97	3,671.92	3,634.30	3,586.98	3,551.04

（注）下線を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

ストラテジック・インカム・ファンド（ノンヘッジクラス）への投資割合を高位に保つことによって、米ドル建ての複数種別の債券等に分散投資を行なうとともに、機動的に配分比率を調整し、トータルリターンの最大化を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

■ストラテジック・インカム・ファンド（ノンヘッジクラス）

米ドル建ての複数種別の債券等に分散投資を行なうとともに、機動的に配分比率を調整し、トータルリターンの最大化を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行なう方針です。

1 万口当りの費用の明細

項 目	第55期～第60期 (2017. 3. 28～2017. 9. 27)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	72円	0.608%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,845円です。
（投信会社）	(22)	(0.188)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
（販売会社）	(48)	(0.404)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託銀行）	(2)	(0.016)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	0	0.004	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	73	0.612	

- （注1）期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。
- （注2）各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。
- （注3）金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。
- （注4）比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2017年 3月28日から2017年 9月27日まで)

決 算 期	第 55 期 ～ 第 60 期			
	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
外国（邦貨建）	84.656	10,911	488.27	63,000

(注 1) 買付は、外国投資信託から支払われた分配金による再投資分を含みます。
(注 2) 金額は受渡し代金。
(注 3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2017年 3月28日から2017年 9月27日まで)

決 算 期	第 55 期 ～ 第 60 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	—	—	1,997	2,000

(注) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
投資信託受益証券

(2017年 3月28日から2017年 9月27日まで)

第 55 期 ～ 第 60 期							
買 付				売 付			
銘 柄	□ 数	金 額	平均単価	銘 柄	□ 数	金 額	平均単価
	千□	千円	円		千□	千円	円
NB STRATEGIC INCOME FUND NON HEDGED CLASS (ケイマン諸島)	31.548	4,100	129	NB STRATEGIC INCOME FUND NON HEDGED CLASS (ケイマン諸島)	488.27	63,000	129

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) 当ファンドにおける当作成期間中の利害関係人との取引状況

当作成期間（第55期～第60期）中における利害関係人との取引はありません。

(2) ダイワ・マネーアセット・マザーファンドにおける当作成期間中の利害関係人との取引状況

(2017年 3月28日から2017年 9月27日まで)

区 分	第 55 期 ～ 第 60 期					
	買付額等 A		B/A	売付額等 C		D/C
	うち利害関係人との取引状況	うち利害関係人との取引状況		うち利害関係人との取引状況	うち利害関係人との取引状況	
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	15,770	3,110	19.7	—	—	—
コール・ローン	1,489,190	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.0%
※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ペーパーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 当作成期間中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当作成期間（第55期～第60期）中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期間における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	第 60 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) NB STRATEGIC INCOME FUND NON HEDGED CLASS	2, 699. 834	352, 490	99. 4

(注 1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注 2) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年 9 月27日現在

項 目	第 60 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	352, 490	98. 6
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	1	0. 0
コール・ローン等、その他	5, 071	1. 4
投資信託財産総額	357, 563	100. 0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 親投資信託残高

種 類	第54期末	第 60 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	1, 999	1	1

(注) 単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2017年 4 月27日)、(2017年 5 月29日)、(2017年 6 月27日)、(2017年 7 月27日)、(2017年 8 月28日)、(2017年 9 月27日) 現在

項 目	第55期末	第56期末	第57期末	第58期末	第59期末	第60期末
(A) 資産	406, 145, 653円	389, 887, 970円	372, 779, 483円	369, 674, 886円	355, 402, 282円	357, 563, 561円
コール・ローン等	5, 267, 555	4, 575, 465	4, 735, 409	5, 108, 115	5, 249, 451	5, 071, 541
投資信託受益証券 (評価額)	398, 876, 299	383, 310, 905	366, 042, 474	364, 565, 172	350, 151, 232	352, 490, 421
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド (評価額)	2, 001, 799	2, 001, 600	2, 001, 600	1, 599	1, 599	1, 599
(B) 負債	2, 786, 695	2, 706, 921	2, 552, 230	2, 536, 802	2, 537, 665	2, 833, 138
未払収益分配金	2, 369, 637	2, 276, 905	2, 175, 777	2, 152, 926	2, 138, 681	2, 096, 935
未払解約金	—	—	—	—	—	363, 957
未払信託報酬	414, 295	424, 476	368, 480	373, 439	386, 005	356, 910
その他未払費用	2, 763	5, 540	7, 973	10, 437	12, 979	15, 336
(C) 純資産総額 (A－B)	403, 358, 958	387, 181, 049	370, 227, 253	367, 138, 084	352, 864, 617	354, 730, 423
元本	338, 519, 643	325, 272, 179	310, 825, 384	307, 560, 958	305, 525, 941	299, 562, 258
次期繰越損益金	64, 839, 315	61, 908, 870	59, 401, 869	59, 577, 126	47, 338, 676	55, 168, 165
(D) 受益権総口数	338, 519, 643口	325, 272, 179口	310, 825, 384口	307, 560, 958口	305, 525, 941口	299, 562, 258口
1 万口当り基準価額 (C／D)	11, 915円	11, 903円	11, 911円	11, 937円	11, 549円	11, 842円

* 第54期末における元本額は337, 509, 426円、当作成期間（第55期～第60期）中における追加設定元本額は5, 993, 614円、同解約元本額は43, 940, 782円です。

* 第60期末の計算口数当りの純資産額は11, 842円です。

■損益の状況

第55期 自2017年 3月28日 至2017年 4月27日	第57期 自2017年 5月30日 至2017年 6月27日	第59期 自2017年 7月28日 至2017年 8月28日				
第56期 自2017年 4月28日 至2017年 5月29日	第58期 自2017年 6月28日 至2017年 7月27日	第60期 自2017年 8月29日 至2017年 9月27日				
項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期
(A) 配当等収益	1, 275, 543円	1, 131, 890円	1, 109, 473円	1, 122, 714円	1, 081, 726円	1, 053, 924円
受取配当金	1, 275, 650	1, 132, 110	1, 109, 651	1, 122, 834	1, 081, 945	1, 054, 166
受取利息	—	2	2	1	—	1
支払利息	△ 107	△ 222	△ 180	△ 121	△ 219	△ 243
(B) 有価証券売買損益	2, 952, 161	1, 179, 153	1, 679, 975	2, 205, 152	△ 10, 398, 265	10, 155, 701
売買益	2, 972, 362	1, 303, 743	1, 754, 516	2, 304, 036	103, 378	10, 277, 800
売買損	△ 20, 201	△ 124, 590	△ 74, 541	△ 98, 884	△ 10, 501, 643	△ 122, 099
(C) 信託報酬等	△ 417, 064	△ 427, 302	△ 370, 913	△ 375, 903	△ 388, 547	△ 359, 267
(D) 当期損益金 (A + B + C)	3, 810, 640	1, 883, 741	2, 418, 535	2, 951, 963	△ 9, 705, 086	10, 850, 358
(E) 前期繰越損益金	△ 17, 227, 588	△ 15, 122, 632	△ 14, 781, 745	△ 14, 343, 337	△ 13, 412, 639	△ 24, 679, 175
(F) 追加信託差損益金	80, 625, 900	77, 424, 666	73, 940, 856	73, 121, 426	72, 595, 082	71, 093, 917
(配当等相当額)	(85, 778, 503)	(82, 542, 382)	(78, 986, 818)	(78, 261, 153)	(77, 847, 332)	(76, 433, 630)
(売買損益相当額)	(△ 5, 152, 603)	(△ 5, 117, 716)	(△ 5, 045, 962)	(△ 5, 139, 727)	(△ 5, 252, 250)	(△ 5, 339, 713)
(G) 合計 (D + E + F)	67, 208, 952	64, 185, 775	61, 577, 646	61, 730, 052	49, 477, 357	57, 265, 100
(H) 収益分配金	△ 2, 369, 637	△ 2, 276, 905	△ 2, 175, 777	△ 2, 152, 926	△ 2, 138, 681	△ 2, 096, 935
次期繰越損益金 (G + H)	64, 839, 315	61, 908, 870	59, 401, 869	59, 577, 126	47, 338, 676	55, 168, 165
追加信託差損益金	80, 625, 900	77, 424, 666	73, 940, 856	73, 121, 426	72, 595, 082	71, 093, 917
(配当等相当額)	(85, 778, 503)	(82, 542, 382)	(78, 986, 818)	(78, 261, 153)	(77, 847, 332)	(76, 433, 630)
(売買損益相当額)	(△ 5, 152, 603)	(△ 5, 117, 716)	(△ 5, 045, 962)	(△ 5, 139, 727)	(△ 5, 252, 250)	(△ 5, 339, 713)
分配準備積立金	41, 254, 766	38, 165, 299	35, 145, 778	33, 515, 775	31, 744, 479	29, 942, 181
繰越損益金	△ 57, 041, 351	△ 53, 681, 095	△ 49, 684, 765	△ 47, 060, 075	△ 57, 000, 885	△ 45, 867, 933

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期
(a) 経費控除後の配当等収益	1,149,607円	922,533円	961,852円	995,876円	693,179円	1,020,153円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	85,778,503	82,542,382	78,986,818	78,261,153	77,847,332	76,433,630
(d) 分配準備積立金	42,474,796	39,519,671	36,359,703	34,672,825	33,189,981	31,018,963
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	129,402,906	122,984,586	116,308,373	113,929,854	111,730,492	108,472,746
(f) 分配金	2,369,637	2,276,905	2,175,777	2,152,926	2,138,681	2,096,935
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	127,033,269	120,707,681	114,132,596	111,776,928	109,591,811	106,375,811
(h) 受益権総口数	338,519,643口	325,272,179口	310,825,384口	307,560,958口	305,525,941口	299,562,258口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
1 万 口 当 り 分 配 金	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期
	70円	70円	70円	70円	70円	70円
（単 価）	(11,915円)	(11,903円)	(11,911円)	(11,937円)	(11,549円)	(11,842円)

●＜分配金再投資コース＞をご利用の方の税引き分配金は、上記（ ）内の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・普通分配金については、20.315％（所得税15％、復興特別所得税0.315％および地方税5％）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合、税率が異なります。
- ・税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

ダイワ・プレミアム・トラストーダイワ／NB・ストラテジック・インカム・ファンド
円ヘッジクラス／ノンヘッジクラス

当ファンド（ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）／為替ヘッジなし（毎月分配型））はケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラストーダイワ／NB・ストラテジック・インカム・ファンド 円ヘッジクラス／ノンヘッジクラス」に投資しておりますが、以下の内容は一部の項目を除きすべてのクラスを合算しております。

（注）2017年9月27日時点で入手しうる直近の状況を掲載しております。

（米ドル建て）

貸借対照表
2017年2月28日

資産

投資資産の評価額（簿価 \$31,604,170）	\$	31,715,556
現金		3,476
外国通貨の評価額（簿価 \$1,453）		5
外国為替先渡契約による評価益		41,703
未収：		
売却済みの投資（繰延受渡）		417,491
売却済みの投資		371,933
利息		102,667
受益証券の発行		16,088
未収変動証拠金		66,132
前払受託会社報酬		12,615
資産合計		32,747,666

負債

外国為替先渡契約による評価損		135
未払：		
購入済みの投資（繰延受渡）		6,007,081
購入済みの投資		332,037
専門家報酬		57,577
運用会社報酬		22,968
保管会社報酬		22,235
償還済み受益証券		14,300

会計および管理会社報酬	7,202
名義書換代理人報酬	1,222
為替取引執行会社報酬	317
為替運用会社報酬	188
その他負債	400
負債合計	6,465,662

純資産	\$ 26,282,004
------------	----------------------

純資産	
通貨セレクトクラス	\$ 1,575,036
通貨分散／N1クラス	151,829
円ヘッジクラス	13,345,723
円ヘッジ／N1クラス	4,873,483
ノンヘッジクラス	3,426,627
ノンヘッジ／N1クラス	2,909,306
	\$ 26,282,004

発行済み受益証券口数

通貨セレクトクラス	2,441,600
通貨分散／N1クラス	194,893
円ヘッジクラス	17,070,024
円ヘッジ／N1クラス	5,111,676
ノンヘッジクラス	2,966,002
ノンヘッジ／N1クラス	2,622,653

受益証券1口当り純資産額

通貨セレクトクラス	\$ 0.645
通貨分散／N1クラス	\$ 0.779
円ヘッジクラス	\$ 0.782
円ヘッジ／N1クラス	\$ 0.953
ノンヘッジクラス	\$ 1.155
ノンヘッジ／N1クラス	\$ 1.109

損益計算書

2017年2月28日に終了した年度

投資収益

受取利息（源泉徴収税 \$15,284 控除後）	\$	751,941
配当収益（源泉徴収税 \$130,362 控除後）		304,178
投資収益合計		1,056,119

費用

運用会社報酬		158,974
保管会社報酬		130,294
専門家報酬		56,150
会計および管理会社報酬		44,877
名義書換代理人報酬		12,783
受託会社報酬		12,566
為替運用会社報酬		3,050
為替取引執行会社報酬		2,107
登録料		1,023
その他費用		2,423
費用合計		424,247

投資純利益		631,872
--------------	--	----------------

実現益（損）および評価益（損）：

実現益（損）：

証券投資	(471,918)
先物取引	(5,580)
スワップ契約	(49,512)
外国為替取引および外国為替先渡契約	854,919

純実現益	327,909
-------------	----------------

評価益（損）の純変動：

証券投資	2,198,283
スワップ契約	16,415
先物取引	(6,476)
外国為替換算および外国為替先渡契約	(709,156)

評価益の純変動	1,499,066
----------------	------------------

純実現・純評価益	1,826,975
-----------------	------------------

運用による純資産の純増	\$ 2,458,847
--------------------	---------------------

ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）／為替ヘッジなし（毎月分配型）

（米ドル建て）

投資明細表
2017年2月28日

	元本	有価証券の明細	対純資産 比率	評価額		元本	有価証券の明細	対純資産 比率	評価額
		債券 (81.8%)			USD	106,777	4.38% due 10/01/22 Carrington Mortgage Loan Trust Series 2005- NC 5 Class M 1 (a), (b)		106,777
		メキシコ (2.4%)							
		国債 (2.4%)			USD	280,000	1.26% due 10/25/35 Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006- NC 1 Class A 4 (a), (b)		259,531
MXN	6,000,000	Mexican Bonos							
		5.75% due 03/05/26	\$	268,486					
MXN	7,520,000	7.75% due 11/13/42		372,469					
		国債合計		640,955	USD	415,000	1.09% due 01/25/36 Carrington Mortgage Loan Trust Series 2006- RFC 1 Class A 4 (a), (b)		389,671
		メキシコ合計 (簿価 \$813,733)		640,955					
		オランダ (0.4%)			USD	415,000	1.02% due 05/25/36 Chase Issuance Trust Series 2016-A 7 Class A 7		387,601
		社債 (0.4%)							
USD	95,000	Mylan NV (a)		92,792	USD	698,000	1.06% due 09/16/19 Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates Series 2005-OPT 3 Class M 3 (a), (b)		697,459
		3.95% due 06/15/26		92,792					
		社債合計		92,792					
		オランダ合計 (簿価 \$94,313)		92,792					
		ニュージーランド (0.4%)			USD	700,000	1.50% due 05/25/35 COMM Mortgage Trust Series 2013-LC 6 Class XB (b), (c)		674,826
		国債 (0.4%)							
NZD	125,000	New Zealand Government Bond		92,437	USD	4,000,000	0.35% due 01/10/46 COMM Mortgage Trust Series 2014-CR17 Class XA (b)		86,256
		2.50% due 09/20/35		92,437					
		国債合計		92,437					
		ニュージーランド合計 (簿 価 \$100,923)		92,437					
		南アフリカ (1.8%)			USD	1,508,163	0.84% due 05/10/47 COMM Mortgage Trust Series 2014-UBS 3 Class XA (b)		82,132
		国債 (1.8%)							
ZAR	8,560,000	Republic of South Africa Government Bond		467,050	USD	1,261,511	1.32% due 06/10/47 CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2005- Ab 1 Class M 1 (a), (b)		76,422
		6.50% due 02/28/41		467,050					
		国債合計		467,050					
		南アフリカ合計 (簿価 \$583,620)		467,050					
		英国 (0.7%)			USD	145,000	1.41% due 08/25/35 GS Mortgage Securities Trust Series 2014-GC18 Class XA (b)		141,225
		社債 (0.7%)							
USD	175,000	Barclays PLC (a)		176,913	USD	1,481,594	1.13% due 01/10/47 GSAA Home Equity Trust Series 2005- 5 Class B 1 (a), (b)		80,388
		4.34% due 01/10/28		176,913					
		社債合計		176,913					
		英国合計 (簿価 \$175,000)		176,913					
		米国 (76.1%)			USD	90,000	2.50% due 02/25/35 Home Equity Asset Trust Series 2005- 1 Class M 5 (a), (b)		80,166
		資産担保証券 (21.6%)							
		Accredited Mortgage Loan Trust 2006- 1 Class A 4 (a), (b)		246,898	USD	65,000	1.87% due 05/25/35		58,808
USD	270,000	1.06% due 04/25/36 American Airlines Pass-Through Trust Series 2014- 1 Class B							

ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）／為替ヘッジなし（毎月分配型）

元本		有価証券の明細	対純資産 比率	評価額	元本		有価証券の明細	対純資産 比率	評価額
USD	50,000	HSI Asset Securitization Corp. Trust Series 2006-OPT 1 Class M 1 (a), (b)		47,577	USD	167,149	Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust Series 2006-AM 1 Class A 4 (a), (b)		163,977
		JP Morgan Mortgage Acquisition Trust Series 2007-CH 1 Class MV 2 (a), (b)					0.94% due 04/25/36		
		資産担保証券合計					5,667,013		
USD	115,000	1.06% due 11/25/36		108,238	USD	70,000	Abbott Laboratories (a)		72,776
		Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust Series 2014-C16 Class XA (b)					4.90% due 11/30/46		
USD	1,550,631	1.19% due 06/15/47		86,489	USD	100,000	AbbVie, Inc. (a)		96,908
		Navient Student Loan Trust Series 2016-6 A Class A 1 (a), (b), (c)					4.45% due 05/14/46		
USD	102,636	1.26% due 03/25/66		102,787	USD	80,000	Air Lease Corp.		79,164
		New Century Home Equity Loan Trust Series 2005-B Class A 2 D (a), (b)					2.13% due 01/15/20		
USD	157,751	1.18% due 10/25/35		155,743	USD	85,000	Anheuser-Busch InBev Finance, Inc. (a)		30,519
		Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates Series 2005-WCH 1 Class M 4 (a), (b)					3.65% due 02/01/26		
		RAAC Trust Series 2006-SP 2 Class M 1 (a), (b)					4.65% due 02/23/46		
USD	303,000	2.02% due 01/25/36		297,141	USD	180,000	AT&T, Inc. (a)		92,426
		RAAC Trust Series 2006-SP 2 Class M 1 (a), (b)					4.75% due 05/15/46		
USD	200,000	1.12% due 02/25/36		185,829	USD	175,000	Bank of America Corp.		168,322
		RAMP Trust Series 2005-RZ 1 Class M 5 (a), (b)					5.70% due 03/01/57		
USD	238,889	1.41% due 10/25/34		228,895	USD	125,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital (a)		125,464
		RAMP Trust Series 2005-RZ 2 Class M 4 (a), (b)					3.95% due 04/21/25		
USD	230,000	1.34% due 05/25/35		219,290	USD	175,000	Discover Financial Services (a)		143,806
		RASC Trust Series 2005-KS10 Class M 2 (a), (b)					4.91% due 07/23/25		
USD	385,000	1.22% due 11/25/35		367,398	USD	130,000	6.48% due 10/23/45		150,887
		Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust Series 2005-WF 4 Class M 4 (a), (b)					Citigroup, Inc.		
USD	350,000	1.36% due 11/25/35		335,489	USD	140,000	4.40% due 06/10/25		143,806
							Diamond 1 Finance Corp. / Diamond 2 Finance Corp. (a), (c)		
							4.42% due 06/15/21		
USD					USD	165,000	4.42% due 06/15/21		173,026
							5.45% due 06/15/23		
USD					USD	145,000	Discover Financial Services (a)		156,699
							4.10% due 02/09/27		
USD					USD	115,000	Energy Transfer Partners LP (a)		115,851
							6.50% due 02/01/42		
USD					USD	75,000	EPR Properties (a)		84,661
							5.75% due 08/15/22		
USD					USD	130,000	ERAC USA Finance LLC (a), (c)		141,987
							4.20% due 11/01/46		
USD					USD	75,000	Ford Motor Co. (a)		70,006
							4.35% due 12/08/26		
USD					USD	95,000			97,695

ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）／為替ヘッジなし（毎月分配型）

元本				有価証券の明細	対純資産 比率	評価額	元本				有価証券の明細	対純資産 比率	評価額
USD	70,000	General Motors Co. (a)		85,013	USD	65,000	3.88% due 04/01/24 (a)		64,745				
		6.75% due 04/01/46			USD	160,000	4.38% due 03/15/43		140,402				
		General Motors Financial Co., Inc. (a)			USD	180,000	5.88% due 02/28/57 (a), (b)		183,301				
USD	110,000	3.20% due 07/06/21		111,297	社債合計				4,898,440				
USD	130,000	4.00% due 10/06/26		129,412	国債 (35.9%)								
USD	95,000	4.30% due 07/13/25		96,783	Federal Home Loan Mortgage Corp., TBA (e)								
USD	90,000	Georgia Power Co. (a)		89,898	USD	395,000	3.00% due 03/01/31		406,353				
		Goldman Sachs Group, Inc.					USD	585,000	3.00% due 03/01/47		580,580		
USD	185,000	2.35% due 11/15/21 (a)		181,207	USD	255,000	3.50% due 03/01/46		261,345				
USD	95,000	5.15% due 05/22/45		101,245	USD	1,040,000	4.00% due 03/01/46		1,093,082				
USD	120,000	Hess Corp. (a)		120,035	Federal National Mortgage Association, TBA (e)								
		4.30% due 04/01/27			USD	255,000	3.00% due 03/01/32		262,212				
		Hewlett Packard Enterprise Co. (a)					USD	630,000	3.00% due 03/01/46		625,767		
USD	155,000	4.90% due 10/15/25		161,282	USD	240,000	3.50% due 03/01/46		246,019				
USD	145,000	HP, Inc.		155,379	USD	1,365,000	4.00% due 03/01/47		1,434,541				
		4.65% due 12/09/21			USD	80,000	4.50% due 03/01/47		85,963				
USD	25,000	Kinder Morgan Energy Partners LP (a)		25,977	Government National Mortgage Association, TBA (e)								
		5.50% due 03/01/44			USD	310,000	3.00% due 03/01/46		313,681				
USD	95,000	Kinder Morgan, Inc. (a)		100,247			3.50% due 03/01/46		109,151				
USD	90,000	Microsoft Corp. (a)		93,386	USD	170,000	4.00% due 03/01/47		179,895				
		4.50% due 02/06/57			Resolution Funding Corp. Interest Strip zero coupon due 04/15/29								
USD	185,000	Morgan Stanley		184,317	USD	145,000	U.S. Treasury Bonds						
USD	85,000	3.63% due 01/20/27		86,396			3.88% due 08/15/40		425,026				
USD	60,000	4.38% due 01/22/47		61,547	USD	30,000	5.50% due 08/15/28		39,110				
		5.45% due 12/31/49 (a), (b), (d)			U.S. Treasury Inflation Indexed Bonds								
USD	85,000	Noble Energy, Inc. (a)		89,613	USD	133,806	2.00% due 01/15/26		153,010				
		5.25% due 11/15/43			USD	106,828	2.50% due 01/15/29		131,863				
USD	55,000	Novartis Capital Corp. (a)		55,087	USD	104,490	3.63% due 04/15/28		140,130				
		3.10% due 05/17/27			USD	1,307,072	3.88% due 04/15/29		1,826,523				
USD	55,000	Omega Healthcare Investors, Inc. (a)		55,046	U.S. Treasury Inflation Indexed Note								
		4.50% due 01/15/25			USD	377,152	0.25% due 01/15/25		376,290				
USD	60,000	Reynolds American, Inc. (a)		63,442			U.S. Treasury Notes						
USD	145,000	4.45% due 06/12/25		141,935	USD	65,000	1.50% due 02/28/23		62,880				
		Seagate HDD Cayman (a), (c)			USD	115,000	1.63% due 02/15/26		108,190				
USD	60,000	4.88% due 03/01/24		52,589	USD	145,000	2.13% due 12/31/21		146,557				
		Verizon Communications, Inc.			USD	70,000	2.75% due 02/15/24		72,557				
USD	114,000	4.13% due 08/15/46		103,785	USD	250,000	3.63% due 08/15/19		263,740				
USD		4.67% due 03/15/55			国債合計				9,444,539				
		Viacom, Inc.											

ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）／為替ヘッジなし（毎月分配型）

為替ヘッジあり（毎月分配型）				為替ヘッジなし（毎月分配型）			
元本	有価証券の明細	対純資産 比率	評価額	元本	有価証券の明細	対純資産 比率	評価額
	米国合計（簿価 \$19,710,110）		20,009,992		グランド・ケイマン (0.1%)		
	債券合計（簿価 \$21,477,699）		21,480,139		定期預金（0.1%） Brown Brothers Harriman & Co.		
口数	上場投資信託（ETF） (27.7%)			EUR	0** -0.58% due 03/01/17		1
	米国（27.7%）			JPY	46,689 -0.20% due 03/01/17		417
	iShares iBoxx \$ High Yield Corporate Bond ETF		1,997,120	GBP	6 0.05% due 03/01/17		7
	iShares JP Morgan USD Emerging Markets Bond ETF		931,192	CAD	54 0.05% due 03/01/17		41
	PowerShares Senior Loan Portfolio		2,353,569	AUD	907 0.49% due 03/01/17		697
	SPDR Bloomberg Barclays High Yield Bond ETF		2,006,530	NZD	839 0.80% due 03/01/17		607
	米国合計		7,288,411	ZAR	280,869 5.45% due 03/01/17		21,473
	上場投資信託（ETF）合計 (簿価 \$7,179,465)		7,288,411		定期預金合計		23,243
					グランド・ケイマン合計 (簿価 \$23,243)		23,243
					スウェーデン（9.2%） 定期預金（9.2%） Skandinaviska Enskilda Banken AB		
USD	短期投資（11.2%）			USD	2,424,532 0.27% due 03/01/17		2,424,532
	米国（1.9%）				定期預金合計		2,424,532
	国債（1.9%）				スウェーデン合計（簿価 \$2,424,532）		2,424,532
	U.S. Treasury Bill*				短期投資合計（簿価 \$2,947,006）		2,947,006
	0.77% due 06/22/17		499,231		投資総額（簿価 \$31,604,170）	120.7%	\$ 31,715,556
	国債合計		499,231		現金および他の資産を超過 する負債	(20.7)	(5,433,552)
	米国合計（簿価 \$499,231）		499,231		純資産	100.0%	\$ 26,282,004

投資明細表のすべての有価証券は運用会社の最善の判断に基づいて有価証券の所在地ではなく、リスクの所在国によって分類されています。

用語集：
TBA To be announced（事後告知）の略。米国政府機関によって発行される不動産ローン担保証券の先渡取引で、合意された将来の決済日に受渡しがされます。

* この証券のすべてもしくは一部が2017年 2月28日時点の先物取引の担保として取引相手に差し入れられています。

**0.05未満

(a) 償還条項付き証券。
(b) 2017年 2月28日時点の変動金利証券。
(c) 144A 証券 - 1933年証券取引法の規則144Aの下でSECへの登録の適用除外になっている証券。これらの証券は、登録せずに主として適格機関投資家に転売が可能です。他に指定がない限り、これらの証券は非流動的だとはみなされません。
(d) 永久債。
(e) 発行日取引または繰延受渡しベースで購入された証券。

2017年2月28日時点の先物取引（純資産の－0.2%）

ポジション	銘柄	限月	枚数	評価益 / (損)
Long	British Pound March Futures	2017年3月	3	\$ (3,762)
Short	Euro Buxl 30 Year Bond June Futures	2017年6月	(4)	(2,975)
Short	Euro FX March Futures	2017年3月	(7)	(4,143)
Short	Euro-Bobl June Futures	2017年6月	(3)	(191)
Short	Euro-Bund June Futures	2017年6月	(1)	(340)
Short	Euro-OAT June Futures	2017年6月	(5)	(1,371)
Short	Long Gilt June Futures	2017年6月	(6)	(15,904)
Short	Mexican Peso March Futures	2017年3月	(4)	(1,950)
Short	New Zealand Dollar March Futures	2017年3月	(1)	(920)
Short	South African Rand (CME) March Futures	2017年3月	(13)	(32,611)
Long	Swedish Krona March Futures	2017年3月	1	2,958
Short	U. S. Treasury 10 Year Note (CBT) June Futures	2017年6月	(15)	(7,735)
Long	U. S. Treasury 10 Year Ultra June Futures	2017年6月	8	8,688
Long	U. S. Treasury Long Bond (CBT) June Futures	2017年6月	4	6,018
Long	U. S. Treasury Ultra Bond (CBT) June Futures	2017年6月	3	6,956
Short	United States Dollar March Futures	2017年3月	(7)	(1,365)
Short	USD IRS 10 Year Prim March Futures	2017年3月	(1)	(639)
				<u>\$ (49,286)</u>

2017年2月28日時点で、中央清算対象スワップ取引の累積マージンとして、\$10,349が支払われました。

2017年2月28日時点の中央清算対象のクレジット・デフォルト・スワップ（純資産の0.1%）

通貨	取引相手	想定元本	信用プロ テクション	インデックス	受取 / (支払)	インプライド 信用スプレッド	満期日	評価益 / (損)
USD	JP Morgan Chase & Co.	717,750	Sell	CDX. NA. HY. 27 Index	5.000%	3.51%	2021年12月20日	\$ 16,538

2017年2月28日時点の通過セレクトクラス外国為替先渡契約（純資産の0.1%）

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価 (損)	純評価益 / (損)
BRL	Citibank N. A.	891,195	2017年3月10日	USD	283,021	\$ 2,858	\$ —	\$ 2,858
IDR	Citibank N. A.	3,332,806,124	2017年3月10日	USD	249,835	—	(135)	(135)
INR	Citibank N. A.	17,448,929	2017年3月10日	USD	259,348	1,921	—	1,921
RUB	Citibank N. A.	15,617,192	2017年3月10日	USD	261,819	4,829	—	4,829
TRY	Citibank N. A.	1,033,187	2017年3月10日	USD	275,581	8,619	—	8,619
ZAR	Citibank N. A.	3,227,894	2017年3月10日	USD	239,352	7,088	—	7,088
						<u>\$ 25,315</u>	<u>\$ (135)</u>	<u>\$ 25,180</u>

ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）／為替ヘッジなし（毎月分配型）

2017年 2月28日時点の円ヘッジクラス外国為替先渡契約（純資産の0.0%）

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価（損）	純評価益 /（損）
JPY	Citibank N. A.	1,491,610,675	2017年 3月10日	USD	13,325,958	\$ 8,369	\$ —	\$ 8,369

2017年 2月28日時点の円ヘッジ／N 1 クラス外国為替先渡契約（純資産の0.0%）

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価（損）	純評価益 /（損）
JPY	Citibank N. A.	546,018,977	2017年 3月10日	USD	4,873,143	\$ 8,019	\$ —	\$ 8,019

2017年 2月28日時点の通貨分散／N 1 クラスのトータル・リターン・スワップ（純資産の0.0%）

想定元本	取引相手	参照法人	通貨	満期日	評価額
141,295	Nomura Securities Co., Ltd.	Nomura 12 Currency Basket Strategy	USD	2017年 3月31日	\$ —

通貨の略称	
AUD	— オーストラリア・ドル
BRL	— ブラジル・レアル
CAD	— カナダ・ドル
EUR	— ユーロ
GBP	— 英ポンド
IDR	— インドネシア・ルピア
INR	— インド・ルピー
JPY	— 日本円
MXN	— メキシコ・ペソ
NZD	— ニュージーランド・ドル
RUB	— ロシア・ルーブル
TRY	— トルコ・リラ
USD	— 米ドル
ZAR	— 南アフリカ・ランド

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）／為替ヘッジなし（毎月分配型））が投資対象としている「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の決算日（2016年12月9日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの第60期の決算日（2017年9月27日）現在におけるダイワ・マネーアセット・マザーファンドの組入資産の内容等を34ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

買 付			(2017年3月28日から2017年9月27日まで)		
銘 柄		金 額	売 付		金 額
		千円			千円
669 国庫短期証券	2017/6/12	3, 020, 099			
657 国庫短期証券	2017/4/17	2, 860, 055			
659 国庫短期証券	2017/4/24	2, 650, 077			
644 国庫短期証券	2017/5/12	2, 070, 088			
660 国庫短期証券	2017/5/1	1, 450, 027			
650 国庫短期証券	2017/6/12	1, 240, 022			
665 国庫短期証券	2017/5/22	700, 026			
671 国庫短期証券	2017/6/19	450, 004			
666 国庫短期証券	2017/5/29	370, 039			
679 国庫短期証券	2017/7/31	350, 003			

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

2017年9月27日現在における該当事項はありません。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

運用報告書 第5期 (決算日 2016年12月9日)

(計算期間 2015年12月10日～2016年12月9日)

ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの第5期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
運用方法	①円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 ②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。
株式組入制限	純資産総額の10%以下

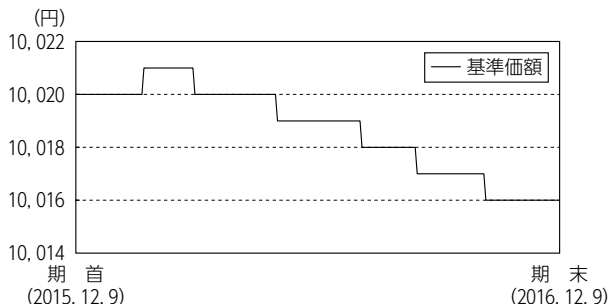
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

■当期中の基準価額の推移



年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 組入比率
	騰 落 率	騰 落 率	
(期首) 2015年12月9日	円	%	%
12月31日	10,020	—	52.7
2016年1月31日	10,020	0.0	52.0
2月31日	10,020	0.0	61.6
3月31日	10,021	0.0	48.5
4月31日	10,020	0.0	32.1
5月31日	10,020	0.0	24.5
6月31日	10,019	△ 0.0	10.5
7月31日	10,019	△ 0.0	10.5
8月31日	10,018	△ 0.0	19.3
9月31日	10,017	△ 0.0	46.5
10月31日	10,017	△ 0.0	26.1
11月31日	10,016	△ 0.0	3.4
(期末) 2016年12月9日	10,016	△ 0.0	26.7
			28.2

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(注3) 当ファンドは、安定した収益の確保をめざして安定運用を行っており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,020円 期末：10,016円 騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】

低金利環境が継続したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市場

期首より、日銀は量的・質的金融緩和を継続し、2016年1月にはマイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入を、9月には長短金利操作付き量的・質的金融緩和の導入を決定しました。このような日銀の金融政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利は低下しました。

◆前期における「今後の運用方針」

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行なっていました。

◆ポートフォリオについて

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等による運用を行ないました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

《今後の運用方針》

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	0

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

	買 付 額	売 付 額
国 内	千円 48,041,830	千円 —
国債証券	(51,515,000)	

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子は含まれておりません）。

(注2) ()内は償還による減少分、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

当		期	
買		売	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
591 国庫短期証券 2016/5/30	4,500,177		
613 国庫短期証券 2016/9/12	3,790,054		
601 国庫短期証券 2016/7/19	3,150,065		
611 国庫短期証券 2016/9/5	3,010,051		
629 国庫短期証券 2016/11/28	2,440,076		
586 国庫短期証券 2016/5/12	2,000,342		
607 国庫短期証券 2016/8/15	1,980,036		
609 国庫短期証券 2016/8/22	1,940,045		
610 国庫短期証券 2016/8/29	1,920,037		
632 国庫短期証券 2016/12/12	1,890,066		

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年12月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	2,960,056	27.4
コール・ローン等、その他	7,832,675	72.6
投資信託財産総額	10,792,732	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内(邦貨建) 公社債(種類別)

区 分	当 期 末						
	額面金額	評価額	組入 比率	うちBB格 以下組入 比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	2,960,000	2,960,056	28.2	—	—	—	28.2

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注3) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2) 国内(邦貨建) 公社債(銘柄別)

当 期 末					
区 分	銘 柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	632 国庫短期証券	—	1,890,000	1,890,015	2016/12/12
	634 国庫短期証券	—	320,000	320,006	2016/12/19
	635 国庫短期証券	—	750,000	750,034	2016/12/26
	3銘柄				
合計	銘柄数 金 額		2,960,000	2,960,056	

(注) 単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	10,792,732,361円
コール・ローン等	7,832,629,033
公社債（評価額）	2,960,056,480
その他未収収益	46,848
(B)負債	300,005,700
未払金	300,005,700
(C)純資産総額（A－B）	10,492,726,661
元本	10,476,400,958
次期繰越損益金	16,325,703
(D)受益権総口数	10,476,400,958口
1万口当り基準価額（C／D）	10,016円

*期首における元本額は12,186,116,869円、当期中における追加設定元本額は1,736,323,360円、同解約元本額は3,446,039,271円です。

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ・グローバル・ハイブリッド証券ファンドⅡ（為替ヘッジあり）999円、ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）999円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクワトロプレミアム（毎月分配型）219,583円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクワトロプレミアム（年2回決算型）24,953円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム（毎月分配型）848,389円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム（年2回決算型）66,873円、ダイワ米国株主還元株ファンド36,730,213円、ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（年1回決算型）4,995円、ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし（年1回決算型）4,995円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-04（為替ヘッジあり／限定追加型）999円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-07（為替ヘッジあり／限定追加型）999円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-10（為替ヘッジあり／限定追加型）999円、世界ハイブリッド証券ファンド2015-01（為替ヘッジあり／限定追加型）999円、ダイワ・ブラジル・レアル債α（毎月分配型）－スーパー・ハインカム－α50コース49,911円、ダイワ・ブラジル・レアル債α（毎月分配型）－スーパー・ハインカム－α100コース49,911円、ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ39,455,979円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11Ver3－1,078,302,562円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11Ver7－1,257,987,220円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11Ver5－2,095,808,384円、ダイワ・スイス高配当株ツインα（毎月分配型）2,996,106円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース5,990,216円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）日本円コース1,397,544円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）ブラジル・レアル・コース3,994,008円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）通貨セレクト・コース1,597,623円、ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）為替ヘッジあり40,885円、ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）為替ヘッジなし100,789円、ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり（毎月分配型）29,988,005円、ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし（毎月分配型）1,999,201円、通貨選択型ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 日本円コース（毎月分配型）1,002,195円、通貨選択型ダイワ／NB・米国債券戦略ファンド 通貨セレクトコース（毎月分配型）3,011,774円、ダイワ新興国ハインカム・プラス－インカムチェンジ（積立型）－1,527,685円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド（限定追加型）－シフト11－3,536,610,361円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド（限定追加型）－シフト12－1,088,870,549円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド（限定追加型）－シフト13－1,287,713,056円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,016円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月10日 至2016年12月9日

項 目	当	期
(A)配当等収益	△	1,082,398円
受取利息		1,776,408
その他収益金		46,848
支払利息	△	2,905,654
(B)有価証券売買損益	△	3,128,171
売買益		40
売買損	△	3,128,211
(C)その他費用	△	111,607
(D)当期損益金（A＋B＋C）	△	4,322,176
(E)前期繰越損益金		24,173,441
(F)解約差損益金	△	6,316,919
(G)追加信託差損益金		2,791,357
(H)合計（D＋E＋F＋G）		16,325,703
次期繰越損益金（H）		16,325,703

（注1）解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

（注2）追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。